# 上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

# 目录

§1 重要提示及目录.....1
1.1 重要提示.....1
1.2 目录.....2
§2 基金简介.....4
2.1 基金基本情况.....4
2.2 基金产品说明.....4
2.3 基金管理人和基金托管人.....4
2.4 信息披露方式.....5
2.5 其他相关资料.....5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....5
3.1 主要会计数据和财务指标.....5
3.2 基金净值表现.....6
§4 管理人报告.....7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....11
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....11
§5 托管人报告.....11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....11
§6 中期财务会计报告（未经审计）.....11
6.1 资产负债表.....11
6.2 利润表.....13
6.3 净资产变动表.....14
6.4 报表附注.....16
§7 投资组合报告.....33
7.1 期末基金资产组合情况.....33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....33
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....46

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....46
7.12 投资组合报告附注.....46
§8 基金份额持有人信息.....47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....48
§9 开放式基金份额变动.....48
§10 重大事件揭示.....49
10.1 基金份额持有人大会决议.....49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....49
10.4 基金投资策略的改变.....49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....50
10.8 其他重大事件.....51
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....51
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....52
§12 备查文件目录.....52
12.1 备查文件目录.....52
12.2 存放地点.....52
12.3 查阅方式.....52

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 南方上证 380ETF |
| 场内简称 | 380ETF；上证 380ETF |
| 基金主代码 | 510290 |
| 交易代码 | 510290 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011 年 9 月 16 日 |
| 基金管理人 | 南方基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 80,448,915.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2011 年 11 月 8 日 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 |
| 业绩比较基准 | 上证 380 指数，简称 380 指数 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|
| 名称 | 南方基金管理股份有限 | 中国建设银行股份有限公司 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 公司 | |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 鲍文革 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 0755-82763888 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | manager@southernfund.com | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-889-8899 | 021-60637228 |
| 传真 | | 0755-82763889 | 021-60635778 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 518017 | 100033 |
| 法定代表人 | | 周易 | 张金良 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.nffund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有） |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 2,773,334.46 |
| 本期利润 | 6,784,095.14 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0791 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.99% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.99% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 84,155,137.76 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.0460 |
| 期末基金资产净值 | 164,604,052.76 |

| | |
|---|---|
| 期末基金份额净值 | 2.0461 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 104.61% |

注：基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

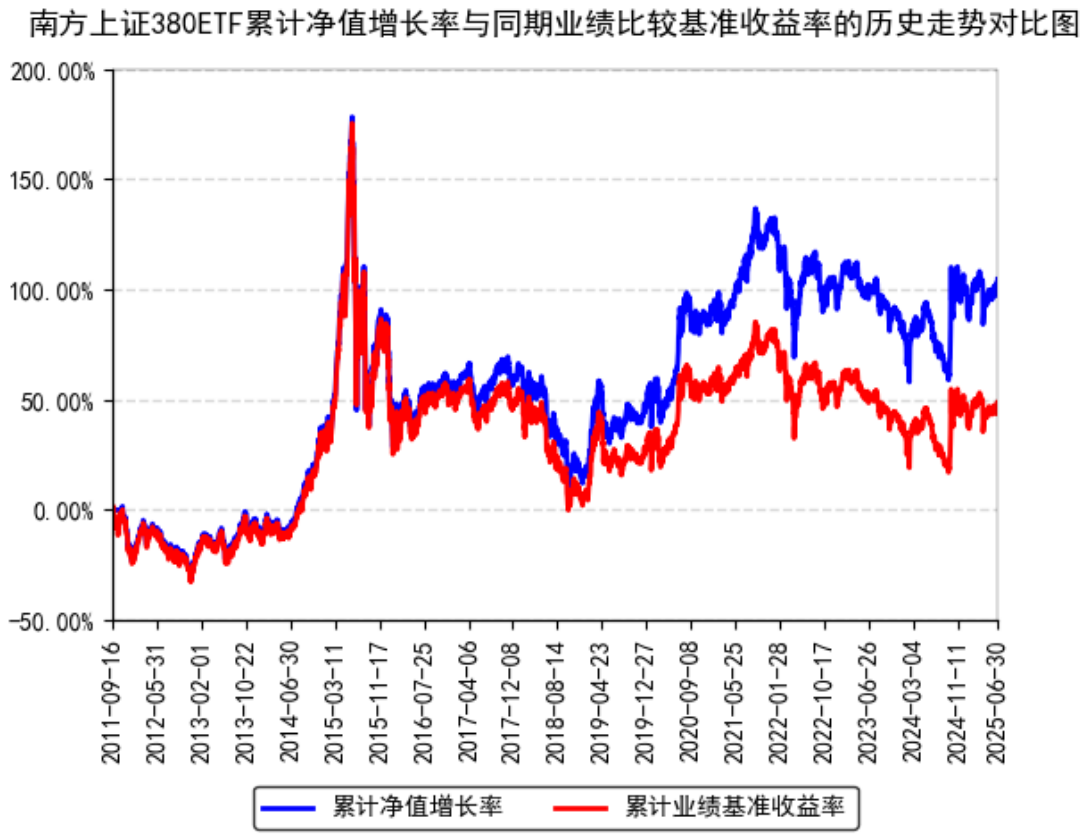
对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 4.23% | 0.66% | 3.32% | 0.67% | 0.91% | -0.01% |
| 过去三个月 | 1.25% | 1.35% | 0.09% | 1.35% | 1.16% | 0.00% |
| 过去六个月 | 3.99% | 1.19% | 2.83% | 1.19% | 1.16% | 0.00% |
| 过去一年 | 15.03% | 1.50% | 12.61% | 1.50% | 2.42% | 0.00% |
| 过去三年 | -3.86% | 1.16% | -9.72% | 1.17% | 5.86% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 104.61% | 1.52% | 48.66% | 1.52% | 55.95% | 0.00% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较




# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | 证券从业 | 说明 |
|---|---|---|---|---|

| | | 任职日期 | 离任日期 | 年限 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 孙伟 | 本基金基金经理 | 2019 年 7 月 12 日 | - | 15 年 | 北京大学工商管理硕士，注册会计师（CPA），具有基金从业资格。曾任职于腾讯科技有限公司投资并购部、德勤华永会计师事务所深圳分所审计部。2010 年 2 月加入南方基金，历任运作保障部基金会计、数量化投资部量化投资研究员、基金经理助理；2015 年 5 月 22 日至 2016 年 7 月 29 日，任南方 500 工业 ETF、南方 500 原材料 ETF 基金经理；2015 年 7 月 2 日至 2020 年 12 月 1 日，任改革基金、高铁基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 7 日，任南方中证 500 工业 ETF 基金经理；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 1 月 14 日，任南方中证 500 原材料 ETF 基金经理；2020 年 12 月 1 日至 2021 年 4 月 19 日，任改革基金基金经理；2015 年 7 月 10 日至今，任 500 信息基金经理；2016 年 5 月 13 日至今，任南方创业板 ETF 基金经理；2016 年 5 月 20 日至今，任南方创业板 ETF 联接基金经理；2016 年 8 月 17 日至今，任 500 信息联接基金经理；2016 年 8 月 19 日至今，任深成 ETF、南方深成基金经理；2017 年 3 月 8 日至今，任南方全指证券 ETF 联接基金经理；2017 年 3 月 10 日至今，任南方中证全指证券 ETF 基金经理；2017 年 6 月 28 日至今，任南方中证银行 ETF 基金经理；2017 年 6 月 29 日至今，任南方银行联接基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任 H 股 ETF 基金经理；2018 年 2 月 12 日至今，任南方 H 股联接基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方上证 380ETF、南方上证 380ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任高铁基金基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理；2023 年 7 月 25 日至今，任南方上海金 ETF 发起联接基金经理。 |

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。 公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占优比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易次数为 96 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，上证 380 指数上涨 2.83%。

上证 380 指数作为反映沪市中等市值上市公司整体表现的重要宽基指数，近年来在结构优化与成分股调整方面展现出积极信号。2025 年 6 月 16 日起，上证 380 指数的编制方案将正式实施优化，旨在提升其对中盘股的代表性，减少与上证 180 指数之间的重叠，从而构建更为清晰的沪市投资链条。此次调整不仅有助于更精准地刻画市场运行特征，也为更多具备成长潜力的企业提供了进入主流指数的机会，增强了指数的包容性与动态适应能力。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本 ETF 基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

（1）新股上市初期涨幅较大的影响；

（2）申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

（3）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；

（4）根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.0461 元，报告期内，份额净值增长率为 3.99%，同期业绩基准增长率为 2.83%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，随着中国经济结构的持续优化和资本市场改革的不断深化，上证 380 指数有望在资源配置效率、市场代表性以及投资吸引力方面进一步提升。尤其是在当前政策鼓励实体经济与资本市场良性互动的环境下，中盘股作为连接大型蓝筹与小型成长股的关键环节，其发展空间值得期待。同时，随着 ESG 理念的普及和相关指数产品的丰富，上证 380 指数有望吸引更多长期资金流入，推动市场风格向价值投资和理性投资转变。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括财务负责人、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、国际业务部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 中期财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 6 月 30 | 上年度末 2024 年 12 月 |
|---|---|---|---|

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | 日 | 31 日 |
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.3.1 | 500,613.72 | 321,505.92 |
| 结算备付金 | | 699.38 | 1,831.48 |
| 存出保证金 | | 315.32 | 1,448.74 |
| 交易性金融资产 | 6.4.3.2 | 164,267,391.53 | 185,811,744.79 |
| 其中：股票投资 | | 164,267,391.53 | 185,811,744.79 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.3.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.3.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.3.5 | - | - |
| 资产总计 | | 164,769,019.95 | 186,136,530.93 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.3.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 1.82 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 66,496.71 | 80,538.87 |
| 应付托管费 | | 13,299.35 | 16,107.78 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.3.6 | 85,169.31 | 201,528.25 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 负债合计 | | 164,967.19 | 298,174.90 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.3.7 | 80,448,915.00 | 94,448,915.00 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.3.8 | 84,155,137.76 | 91,389,441.03 |
| 净资产合计 | | 164,604,052.76 | 185,838,356.03 |
| 负债和净资产总计 | | 164,769,019.95 | 186,136,530.93 |

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.0461 元，基金份额总额 80,448,915.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| 一、营业总收入 | | 7,381,705.57 | -5,327,659.66 |
| 1.利息收入 | | 752.05 | 1,246.51 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.3.9 | 752.05 | 1,246.51 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 3,370,192.84 | -848,893.57 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.3.10 | 1,220,043.81 | -3,718,998.34 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.3.11 | 26,405.82 | 11,150.37 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.3.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.3.13 | - | -51,431.82 |
| 股利收益 | 6.4.3.14 | 2,123,743.21 | 2,910,386.22 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损 | 6.4.3.15 | 4,010,760.68 | -4,481,818.39 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 失以“-”号填列） | | | |
| 4.汇兑收益（损失以“－”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.3.16 | - | 1,805.79 |
| 减：二、营业总支出 | | 597,610.43 | 662,754.46 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.6.2.1 | 422,031.30 | 423,378.35 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2.托管费 | 6.4.6.2.2 | 84,406.28 | 84,675.72 |
| 3.销售服务费 | 6.4.6.2.3 | - | - |
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6.信用减值损失 | | - | - |
| 7.税金及附加 | | 0.03 | 0.03 |
| 8.其他费用 | 6.4.3.17 | 91,172.82 | 154,700.36 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 6,784,095.14 | -5,990,414.12 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 6,784,095.14 | -5,990,414.12 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 6,784,095.14 | -5,990,414.12 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：上证 380 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 94,448,915.00 | - | 91,389,441.03 | 185,838,356.03 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 94,448,915.00 | - | 91,389,441.03 | 185,838,356.03 |
| 三、本期增减变 | -14,000,000.00 | - | -7,234,303.27 | -21,234,303.27 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 动额（减少以“-”号填列） | | | | |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 6,784,095.14 | 6,784,095.14 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -14,000,000.00 | - | -14,018,398.41 | -28,018,398.41 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,000,000.00 | - | 2,041,896.58 | 4,041,896.58 |
| 2.基金赎回款 | -16,000,000.00 | - | -16,060,294.99 | -32,060,294.99 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 80,448,915.00 | - | 84,155,137.76 | 164,604,052.76 |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 92,448,915.00 | - | 78,837,796.36 | 171,286,711.36 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 92,448,915.00 | - | 78,837,796.36 | 171,286,711.36 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -2,000,000.00 | - | -8,405,376.17 | -10,405,376.17 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -5,990,414.12 | -5,990,414.12 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以 | -2,000,000.00 | - | -2,414,962.05 | -4,414,962.05 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| “-”号填列） | | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 6,000,000.00 | - | 4,577,570.97 | 10,577,570.97 |
| 2.基金赎回款 | -8,000,000.00 | - | -6,992,533.02 | -14,992,533.02 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 90,448,915.00 | - | 70,432,420.19 | 160,881,335.19 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____杨小松___ ____蔡忠评_____ ____徐超____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.3 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.3.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 活期存款 | 500,613.72 |
| 等于：本金 | 500,548.93 |
| 加：应计利息 | 64.79 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 500,613.72 |

### 6.4.3.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 169,578,222.83 | - | 164,267,391.53 | -5,310,831.30 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 169,578,222.83 | - | 164,267,391.53 | -5,310,831.30 |

### 6.4.3.3 衍生金融资产/负债

### 6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

### 6.4.3.4 买入返售金融资产

### 6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

#### 6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.3.5 其他资产

无。

### 6.4.3.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 |
| --- | --- |
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 5,826.15 |
| 其中：交易所市场 | 5,826.15 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 应退退补款 | - |
| 预提费用 | 79,343.16 |
| 应付指数使用费 | - |
| 可退替代款 | - |
| 合计 | 85,169.31 |

### 6.4.3.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | |
| --- | --- | --- |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 94,448,915.00 | 94,448,915.00 |
| 本期申购 | 2,000,000.00 | 2,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -16,000,000.00 | -16,000,000.00 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 80,448,915.00 | 80,448,915.00 |

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

### 6.4.3.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| --- | --- | --- | --- |
| 上年度末 | 102,628,496.08 | -11,239,055.05 | 91,389,441.03 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 102,628,496.08 | -11,239,055.05 | 91,389,441.03 |
| 本期利润 | 2,773,334.46 | 4,010,760.68 | 6,784,095.14 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -15,150,473.13 | 1,132,074.72 | -14,018,398.41 |
| 其中：基金申购款 | 2,158,052.18 | -116,155.60 | 2,041,896.58 |
| 基金赎回款 | -17,308,525.31 | 1,248,230.32 | -16,060,294.99 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 90,251,357.41 | -6,096,219.65 | 84,155,137.76 |

### 6.4.3.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 673.46 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 77.32 |
| 其他 | 1.27 |
| 合计 | 752.05 |

### 6.4.3.10 股票投资收益

#### 6.4.3.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 2,098,422.44 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -878,378.63 |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | 1,220,043.81 |

#### 6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 30,183,163.27 |
| 减：卖出股票成本总额 | 28,059,572.18 |
| 减：交易费用 | 25,168.65 |
| 买卖股票差价收入 | 2,098,422.44 |

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

#### 6.4.3.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| --- | --- |
| 赎回基金份额对价总额 | 32,060,294.99 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 61,070.99 |
| 减：赎回股票成本总额 | 32,877,602.63 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | -878,378.63 |

### 6.4.3.11 债券投资收益

#### 6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| --- | --- |
| 债券投资收益——利息收入 | 13.94 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 26,391.88 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 26,405.82 |

#### 6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| --- | --- |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 118,410.82 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 92,000.00 |
| 减：应计利息总额 | 14.19 |
| 减：交易费用 | 4.75 |
| 买卖债券差价收入 | 26,391.88 |

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

### 6.4.3.12 资产支持证券投资收益

#### 6.4.3.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

### 6.4.3.13 衍生工具收益

#### 6.4.3.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

#### 6.4.3.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

### 6.4.3.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,123,743.21 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 2,123,743.21 |

### 6.4.3.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 4,010,760.68 |
| ——股票投资 | 4,010,760.68 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| ——期货投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 4,010,760.68 |

### 6.4.3.16 其他收入

无。

### 6.4.3.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 19,835.79 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 指数使用费 | 11,664.32 |
| 银行费用 | 155.00 |
| 其他 | 10.34 |
| 合计 | 91,172.82 |

### 6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.4.1 或有事项

无。

#### 6.4.4.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

### 6.4.5 关联方关系

#### 6.4.5.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

#### 6.4.5.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
| --- | --- |
| 南方基金管理股份有限公司(“南方基金”) | 基金管理人 |
| 中国建设银行股份有限公司("中国建设银行") | 基金托管人 |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 华泰联合证券有限责任公司("华泰联合") | 基金管理人的股东华泰证券控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.6.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 60,312,510.47 | 98.18% | 2,627,566.01 | 4.62% |

##### 6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 103,791.61 | 87.65% | - | - |

##### 6.4.6.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.6.1.4 权证交易

无。

#### 6.4.6.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华泰证券 | 6,037.06 | 98.18% | 5,826.19 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 华泰证券 | 262.77 | 4.62% | 26.25 | 0.51% |

注：1.上述佣金费率参考市场价格确定。

2.该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3 号）相关规定。《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》生效后，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

### 6.4.6.2 关联方报酬

#### 6.4.6.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 422,031.30 | 423,378.35 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 4,975.03 | - |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 417,056.27 | 423,378.35 |

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

#### 6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 84,406.28 | 84,675.72 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

#### 6.4.6.2.3 销售服务费

无。

### 6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

### 6.4.6.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

#### 6.4.6.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.6.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

### 6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.6.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 华泰证券股份有限公司 | 431,400.00 | 0.54% | 431,400.00 | 0.46% |
| 中国建设银行股份有限公司－南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 67,991,541.00 | 84.52% | 76,513,441.00 | 81.01% |

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

### 6.4.6.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 |
|---|---|---|

| | 月 30 日 | | 2024 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 500,613.72 | 673.46 | 1,028,446.66 | 593.39 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

### 6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

| 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 华泰联合 | 688757 | 胜科纳米 | 网下申购 | 5,357 | 48,641.56 |

| 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：股/张） | 总金额 |
| 华泰联合 | - | - | - | - | - |

### 6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.7 利润分配情况

### 6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

### 6.4.8 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.8.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688775 | 影石创新 | 2025 年 6 月 4 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 47.27 | 124.16 | 128 | 6,050.56 | 15,892.48 | - |
| 688757 | 胜科纳米 | 2025 年 3 月 18 日 | 6 个月 | 新股锁定期 | 9.08 | 25.94 | 536 | 4,866.88 | 13,903.84 | - |

### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.9 金融工具风险及管理

#### 6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是完全被动式指数基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。紧密跟踪上证 380 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪上证 380 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金净资产的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

### 6.4.9.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金为履行与金融负债有关的义务而调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行期货投资，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

#### 6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产

净值的 15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

###### 6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 500,613.72 | - | - | - | 500,613.72 |
| 结算备付金 | 699.38 | - | - | - | 699.38 |
| 存出保证金 | 315.32 | - | - | - | 315.32 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 164,267,391.53 | 164,267,391.53 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 其他债权投资 | - | - | - | - | - |
| 其他权益工具投资 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 501,628.42 | - | - | 164,267,391.53 | 164,769,019.95 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | 1.82 | 1.82 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 66,496.71 | 66,496.71 |
| 应付托管费 | - | - | - | 13,299.35 | 13,299.35 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 85,169.31 | 85,169.31 |
| 负债总计 | - | - | - | 164,967.19 | 164,967.19 |
| 利率敏感度缺口 | 501,628.42 | - | - | 164,102,424.34 | 164,604,052.76 |
| 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 321,505.92 | - | - | - | 321,505.92 |
| 结算备付金 | 1,831.48 | - | - | - | 1,831.48 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 存出保证金 | 1,448.74 | - | - | - | 1,448.74 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 185,811,744.79 | 185,811,744.79 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 债权投资 | - | - | - | - | - |
| 其他债权投资 | - | - | - | - | - |
| 其他权益工具投资 | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 324,786.14 | - | - | 185,811,744.79 | 186,136,530.93 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 80,538.87 | 80,538.87 |
| 应付托管费 | - | - | - | 16,107.78 | 16,107.78 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 201,528.25 | 201,528.25 |
| 负债总计 | - | - | - | 298,174.90 | 298,174.90 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 利率敏感度缺口 | 324,786.14 | - | - | 185,513,569.89 | 185,838,356.03 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

### 6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（ 2025 年 6 月 30 日 ） | 上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ） |
| | 1.市场利率平行上升 25 个基点 | 0.00 | 0.00 |
| | 2.市场利率平行下降 25 个基点 | 0.00 | 0.00 |

### 6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产-股票投资 | 164,267,391.53 | 99.80 | 185,811,744.79 | 99.99 |
| 交易性金融资产-基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产-贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产-权 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 证投资 | | | | |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 164,267,391.53 | 99.80 | 185,811,744.79 | 99.99 |

### 6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（ 2025 年 6 月 30 日 ） | 上年度末（ 2024 年 12 月 31 日 ） |
| | 1.组合自身基准上升 5% | 8,181,958.42 | 9,227,458.24 |
| | 2.组合自身基准下降 5% | -8,181,958.42 | -9,227,458.24 |

## 6.4.10 公允价值

### 6.4.10.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.10.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 第一层次 | 164,237,595.21 |
| 第二层次 | - |
| 第三层次 | 29,796.32 |
| 合计 | 164,267,391.53 |

#### 6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

### 6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

### 6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

### 6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

# §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 164,267,391.53 | 99.70 |
| | 其中：股票 | 164,267,391.53 | 99.70 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 501,313.10 | 0.30 |
| 8 | 其他各项资产 | 315.32 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 164,769,019.95 | 100.00 |

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而行业分类的合计项中不含可退替代款估值增值。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 396,550.00 | 0.24 |
| B | 采矿业 | 9,323,711.91 | 5.66 |
| C | 制造业 | 101,074,357.37 | 61.40 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 6,788,377.40 | 4.12 |
| E | 建筑业 | 2,866,375.50 | 1.74 |
| F | 批发和零售业 | 3,954,304.24 | 2.40 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 3,741,053.57 | 2.27 |
| H | 住宿和餐饮业 | 365,514.84 | 0.22 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 10,061,930.80 | 6.11 |
| J | 金融业 | 13,929,957.33 | 8.46 |
| K | 房地产业 | 3,928,210.32 | 2.39 |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,299,691.82 | 1.40 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,074,786.12 | 0.65 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,665,615.03 | 1.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 499,488.00 | 0.30 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,590,898.00 | 0.97 |
| S | 综合 | 676,772.96 | 0.41 |
| | 合计 | 164,237,595.21 | 99.78 |

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 15,892.48 | 0.01 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 13,903.84 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 29,796.32 | 0.02 |

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600988 | 赤峰黄金 | 64,300 | 1,599,784.00 | 0.97 |
| 2 | 600839 | 四川长虹 | 142,800 | 1,388,016.00 | 0.84 |
| 3 | 601555 | 东吴证券 | 153,700 | 1,344,875.00 | 0.82 |
| 4 | 689009 | 九号公司 | 22,132 | 1,309,550.44 | 0.80 |
| 5 | 603893 | 瑞芯微 | 8,100 | 1,230,066.00 | 0.75 |
| 6 | 600487 | 亨通光电 | 76,300 | 1,167,390.00 | 0.71 |
| 7 | 600157 | 永泰能源 | 858,900 | 1,150,926.00 | 0.70 |
| 8 | 688608 | 恒玄科技 | 3,241 | 1,127,803.18 | 0.69 |
| 9 | 600460 | 士兰微 | 45,000 | 1,116,900.00 | 0.68 |
| 10 | 688213 | 思特威 | 10,849 | 1,108,984.78 | 0.67 |
| 11 | 688777 | 中控技术 | 24,394 | 1,095,534.54 | 0.67 |
| 12 | 600096 | 云天化 | 49,300 | 1,083,121.00 | 0.66 |
| 13 | 688120 | 华海清科 | 6,406 | 1,080,692.20 | 0.66 |
| 14 | 600536 | 中国软件 | 23,002 | 1,075,803.54 | 0.65 |
| 15 | 601168 | 西部矿业 | 64,500 | 1,072,635.00 | 0.65 |
| 16 | 600879 | 航天电子 | 102,000 | 1,067,940.00 | 0.65 |
| 17 | 600256 | 广汇能源 | 175,800 | 1,058,316.00 | 0.64 |
| 18 | 600219 | 南山铝业 | 269,400 | 1,031,802.00 | 0.63 |
| 19 | 600352 | 浙江龙盛 | 100,600 | 1,022,096.00 | 0.62 |
| 20 | 600885 | 宏发股份 | 45,176 | 1,007,876.56 | 0.61 |
| 21 | 601108 | 财通证券 | 125,700 | 994,287.00 | 0.60 |
| 22 | 688002 | 睿创微纳 | 14,069 | 980,890.68 | 0.60 |
| 23 | 688617 | 惠泰医疗 | 3,206 | 952,182.00 | 0.58 |
| 24 | 601128 | 常熟银行 | 128,249 | 945,195.13 | 0.57 |
| 25 | 601577 | 长沙银行 | 93,300 | 927,402.00 | 0.56 |
| 26 | 600079 | 人福医药 | 44,200 | 927,316.00 | 0.56 |
| 27 | 688099 | 晶晨股份 | 12,993 | 922,632.93 | 0.56 |
| 28 | 688469 | 芯联集成 | 191,290 | 912,453.30 | 0.55 |
| 29 | 688122 | 西部超导 | 17,540 | 909,975.20 | 0.55 |
| 30 | 603129 | 春风动力 | 4,100 | 887,650.00 | 0.54 |
| 31 | 600109 | 国金证券 | 100,500 | 881,385.00 | 0.54 |
| 32 | 600161 | 天坛生物 | 45,900 | 880,821.00 | 0.54 |
| 33 | 603596 | 伯特利 | 16,440 | 866,223.60 | 0.53 |
| 34 | 600862 | 中航高科 | 32,300 | 842,384.00 | 0.51 |
| 35 | 600580 | 卧龙电驱 | 42,338 | 837,022.26 | 0.51 |
| 36 | 601198 | 东兴证券 | 75,000 | 836,250.00 | 0.51 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 37 | 603606 | 东方电缆 | 16,000 | 827,360.00 | 0.50 |
| 38 | 600298 | 安琪酵母 | 23,500 | 826,495.00 | 0.50 |
| 39 | 600873 | 梅花生物 | 77,200 | 825,268.00 | 0.50 |
| 40 | 600363 | 联创光电 | 14,000 | 816,620.00 | 0.50 |
| 41 | 688578 | 艾力斯 | 8,678 | 807,401.12 | 0.49 |
| 42 | 603659 | 璞泰来 | 41,300 | 775,614.00 | 0.47 |
| 43 | 600549 | 厦门钨业 | 36,800 | 769,856.00 | 0.47 |
| 44 | 600895 | 张江高科 | 29,900 | 768,430.00 | 0.47 |
| 45 | 603605 | 珀莱雅 | 9,200 | 761,668.00 | 0.46 |
| 46 | 603160 | 汇顶科技 | 10,700 | 760,021.00 | 0.46 |
| 47 | 600171 | 上海贝岭 | 21,920 | 750,760.00 | 0.46 |
| 48 | 600061 | 国投资本 | 98,900 | 743,728.00 | 0.45 |
| 49 | 605589 | 圣泉集团 | 26,200 | 727,050.00 | 0.44 |
| 50 | 601216 | 君正集团 | 130,500 | 720,360.00 | 0.44 |
| 51 | 600332 | 白云山 | 27,200 | 716,992.00 | 0.44 |
| 52 | 603005 | 晶方科技 | 25,180 | 714,860.20 | 0.43 |
| 53 | 600392 | 盛和资源 | 54,160 | 713,287.20 | 0.43 |
| 54 | 601665 | 齐鲁银行 | 112,700 | 712,264.00 | 0.43 |
| 55 | 601997 | 贵阳银行 | 113,100 | 705,744.00 | 0.43 |
| 56 | 603236 | 移远通信 | 8,139 | 698,326.20 | 0.42 |
| 57 | 600153 | 建发股份 | 67,300 | 697,901.00 | 0.42 |
| 58 | 600060 | 海信视像 | 30,300 | 697,506.00 | 0.42 |
| 59 | 600918 | 中泰证券 | 107,800 | 693,154.00 | 0.42 |
| 60 | 601717 | 中创智领 | 41,700 | 693,054.00 | 0.42 |
| 61 | 601990 | 南京证券 | 85,500 | 690,840.00 | 0.42 |
| 62 | 601233 | 桐昆股份 | 65,100 | 690,060.00 | 0.42 |
| 63 | 688019 | 安集科技 | 4,544 | 689,779.20 | 0.42 |
| 64 | 601696 | 中银证券 | 64,400 | 688,436.00 | 0.42 |
| 65 | 601799 | 星宇股份 | 5,500 | 687,500.00 | 0.42 |
| 66 | 603300 | 海南华铁 | 61,500 | 685,725.00 | 0.42 |
| 67 | 600673 | 东阳光 | 58,192 | 676,772.96 | 0.41 |
| 68 | 603979 | 金诚信 | 14,500 | 673,380.00 | 0.41 |
| 69 | 688037 | 芯源微 | 6,206 | 665,283.20 | 0.40 |
| 70 | 600699 | 均胜电子 | 38,100 | 664,464.00 | 0.40 |
| 71 | 600118 | 中国卫星 | 22,900 | 654,253.00 | 0.40 |
| 72 | 600177 | 雅戈尔 | 89,400 | 652,620.00 | 0.40 |
| 73 | 600521 | 华海药业 | 35,000 | 652,050.00 | 0.40 |
| 74 | 600642 | 申能股份 | 75,700 | 651,020.00 | 0.40 |
| 75 | 600398 | 海澜之家 | 92,800 | 645,888.00 | 0.39 |
| 76 | 600435 | 北方导航 | 40,800 | 636,072.00 | 0.39 |
| 77 | 603345 | 安井食品 | 7,900 | 635,318.00 | 0.39 |
| 78 | 600704 | 物产中大 | 120,400 | 634,508.00 | 0.39 |
| 79 | 600909 | 华安证券 | 108,500 | 632,555.00 | 0.38 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 80 | 688249 | 晶合集成 | 30,950 | 627,356.50 | 0.38 |
| 81 | 600316 | 洪都航空 | 16,600 | 625,820.00 | 0.38 |
| 82 | 603179 | 新泉股份 | 13,200 | 620,004.00 | 0.38 |
| 83 | 600765 | 中航重机 | 36,500 | 616,120.00 | 0.37 |
| 84 | 600141 | 兴发集团 | 29,900 | 613,847.00 | 0.37 |
| 85 | 600038 | 中直股份 | 15,800 | 613,198.00 | 0.37 |
| 86 | 688166 | 博瑞医药 | 11,406 | 612,616.26 | 0.37 |
| 87 | 688385 | 复旦微电 | 12,429 | 612,376.83 | 0.37 |
| 88 | 601567 | 三星医疗 | 27,283 | 611,684.86 | 0.37 |
| 89 | 603228 | 景旺电子 | 14,480 | 605,843.20 | 0.37 |
| 90 | 600562 | 国睿科技 | 19,200 | 604,608.00 | 0.37 |
| 91 | 601677 | 明泰铝业 | 48,100 | 597,402.00 | 0.36 |
| 92 | 603063 | 禾望电气 | 17,500 | 592,550.00 | 0.36 |
| 93 | 688188 | 柏楚电子 | 4,449 | 585,755.34 | 0.36 |
| 94 | 600498 | 烽火通信 | 27,500 | 578,325.00 | 0.35 |
| 95 | 603939 | 益丰药房 | 23,400 | 572,598.00 | 0.35 |
| 96 | 600563 | 法拉电子 | 5,227 | 570,213.43 | 0.35 |
| 97 | 600529 | 山东药玻 | 25,680 | 568,555.20 | 0.35 |
| 98 | 688568 | 中科星图 | 15,612 | 562,188.12 | 0.34 |
| 99 | 688208 | 道通科技 | 18,135 | 554,931.00 | 0.34 |
| 100 | 600486 | 扬农化工 | 9,477 | 549,666.00 | 0.33 |
| 101 | 600901 | 江苏金租 | 89,600 | 542,976.00 | 0.33 |
| 102 | 688017 | 绿的谐波 | 4,195 | 523,913.55 | 0.32 |
| 103 | 688472 | 阿特斯 | 57,100 | 522,465.00 | 0.32 |
| 104 | 603806 | 福斯特 | 40,300 | 522,288.00 | 0.32 |
| 105 | 600820 | 隧道股份 | 85,100 | 519,110.00 | 0.32 |
| 106 | 600863 | 内蒙华电 | 126,200 | 518,682.00 | 0.32 |
| 107 | 688116 | 天奈科技 | 11,332 | 518,665.64 | 0.32 |
| 108 | 600132 | 重庆啤酒 | 9,400 | 517,940.00 | 0.31 |
| 109 | 600008 | 首创环保 | 170,240 | 514,124.80 | 0.31 |
| 110 | 603444 | 吉比特 | 1,700 | 513,315.00 | 0.31 |
| 111 | 603920 | 世运电路 | 16,750 | 511,042.50 | 0.31 |
| 112 | 603568 | 伟明环保 | 26,352 | 502,796.16 | 0.31 |
| 113 | 600998 | 九州通 | 97,430 | 500,790.20 | 0.30 |
| 114 | 688538 | 和辉光电 | 213,883 | 500,486.22 | 0.30 |
| 115 | 600763 | 通策医疗 | 12,100 | 499,488.00 | 0.30 |
| 116 | 688333 | 铂力特 | 8,385 | 499,410.60 | 0.30 |
| 117 | 600577 | 精达股份 | 66,500 | 494,760.00 | 0.30 |
| 118 | 600170 | 上海建工 | 206,100 | 492,579.00 | 0.30 |
| 119 | 603083 | 剑桥科技 | 10,400 | 491,920.00 | 0.30 |
| 120 | 600208 | 衢州发展 | 164,500 | 486,920.00 | 0.30 |
| 121 | 601179 | 中国西电 | 79,300 | 486,902.00 | 0.30 |
| 122 | 603816 | 顾家家居 | 19,066 | 486,564.32 | 0.30 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 123 | 600446 | 金证股份 | 25,558 | 484,835.26 | 0.29 |
| 124 | 600120 | 浙江东方 | 79,224 | 479,305.20 | 0.29 |
| 125 | 600021 | 上海电力 | 54,400 | 478,176.00 | 0.29 |
| 126 | 600559 | 老白干酒 | 28,259 | 473,338.25 | 0.29 |
| 127 | 600985 | 淮北矿业 | 41,600 | 471,744.00 | 0.29 |
| 128 | 600380 | 健康元 | 42,386 | 467,517.58 | 0.28 |
| 129 | 600583 | 海油工程 | 85,500 | 466,830.00 | 0.28 |
| 130 | 601000 | 唐山港 | 114,532 | 464,999.92 | 0.28 |
| 131 | 600348 | 华阳股份 | 69,700 | 464,202.00 | 0.28 |
| 132 | 603338 | 浙江鼎力 | 9,778 | 463,477.20 | 0.28 |
| 133 | 688728 | 格科微 | 30,090 | 463,386.00 | 0.28 |
| 134 | 601236 | 红塔证券 | 54,700 | 463,309.00 | 0.28 |
| 135 | 603613 | 国联股份 | 19,476 | 461,386.44 | 0.28 |
| 136 | 600323 | 瀚蓝环境 | 18,877 | 459,654.95 | 0.28 |
| 137 | 603885 | 吉祥航空 | 34,000 | 457,980.00 | 0.28 |
| 138 | 601991 | 大唐发电 | 143,800 | 455,846.00 | 0.28 |
| 139 | 688484 | 南芯科技 | 11,513 | 455,339.15 | 0.28 |
| 140 | 688278 | 特宝生物 | 6,276 | 452,562.36 | 0.27 |
| 141 | 688200 | 华峰测控 | 3,134 | 451,922.80 | 0.27 |
| 142 | 601865 | 福莱特 | 29,400 | 447,174.00 | 0.27 |
| 143 | 600095 | 湘财股份 | 44,200 | 443,326.00 | 0.27 |
| 144 | 601528 | 瑞丰银行 | 75,900 | 439,461.00 | 0.27 |
| 145 | 600970 | 中材国际 | 50,980 | 437,408.40 | 0.27 |
| 146 | 600499 | 科达制造 | 44,500 | 436,100.00 | 0.26 |
| 147 | 601880 | 辽港股份 | 289,900 | 434,850.00 | 0.26 |
| 148 | 603927 | 中科软 | 22,448 | 434,144.32 | 0.26 |
| 149 | 601016 | 节能风电 | 150,100 | 433,789.00 | 0.26 |
| 150 | 688005 | 容百科技 | 19,296 | 430,686.72 | 0.26 |
| 151 | 688187 | 时代电气 | 10,054 | 428,803.10 | 0.26 |
| 152 | 601611 | 中国核建 | 46,600 | 428,254.00 | 0.26 |
| 153 | 600761 | 安徽合力 | 24,100 | 427,534.00 | 0.26 |
| 154 | 601666 | 平煤股份 | 57,411 | 425,415.51 | 0.26 |
| 155 | 603298 | 杭叉集团 | 20,280 | 424,866.00 | 0.26 |
| 156 | 603737 | 三棵树 | 11,419 | 420,790.15 | 0.26 |
| 157 | 601456 | 国联民生 | 40,500 | 419,175.00 | 0.25 |
| 158 | 603678 | 火炬电子 | 11,000 | 418,330.00 | 0.25 |
| 159 | 603077 | 和邦生物 | 239,000 | 418,250.00 | 0.25 |
| 160 | 600655 | 豫园股份 | 75,300 | 417,915.00 | 0.25 |
| 161 | 601966 | 玲珑轮胎 | 28,300 | 415,161.00 | 0.25 |
| 162 | 600483 | 福能股份 | 43,010 | 414,616.40 | 0.25 |
| 163 | 600325 | 华发股份 | 85,100 | 414,437.00 | 0.25 |
| 164 | 603899 | 晨光股份 | 14,242 | 412,875.58 | 0.25 |
| 165 | 600131 | 国网信通 | 23,200 | 410,640.00 | 0.25 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 166 | 601958 | 金钼股份 | 37,400 | 409,156.00 | 0.25 |
| 167 | 600633 | 浙数文化 | 29,400 | 406,896.00 | 0.25 |
| 168 | 688301 | 奕瑞科技 | 4,644 | 406,860.84 | 0.25 |
| 169 | 600378 | 昊华科技 | 15,000 | 406,050.00 | 0.25 |
| 170 | 600663 | 陆家嘴 | 45,640 | 404,370.40 | 0.25 |
| 171 | 603833 | 欧派家居 | 7,100 | 400,795.00 | 0.24 |
| 172 | 600282 | 南钢股份 | 95,300 | 400,260.00 | 0.24 |
| 173 | 600285 | 羚锐制药 | 17,577 | 398,470.59 | 0.24 |
| 174 | 600598 | 北大荒 | 27,500 | 396,550.00 | 0.24 |
| 175 | 601001 | 晋控煤业 | 32,400 | 395,928.00 | 0.24 |
| 176 | 605111 | 新洁能 | 12,872 | 395,685.28 | 0.24 |
| 177 | 600338 | 西藏珠峰 | 35,320 | 391,698.80 | 0.24 |
| 178 | 600737 | 中粮糖业 | 41,300 | 390,285.00 | 0.24 |
| 179 | 688082 | 盛美上海 | 3,404 | 387,851.76 | 0.24 |
| 180 | 600850 | 电科数字 | 15,942 | 385,636.98 | 0.23 |
| 181 | 600216 | 浙江医药 | 26,035 | 385,057.65 | 0.23 |
| 182 | 600582 | 天地科技 | 63,960 | 383,120.40 | 0.23 |
| 183 | 600566 | 济川药业 | 14,300 | 376,519.00 | 0.23 |
| 184 | 603712 | 七一二 | 17,900 | 376,079.00 | 0.23 |
| 185 | 600667 | 太极实业 | 56,995 | 375,027.10 | 0.23 |
| 186 | 603728 | 鸣志电器 | 6,520 | 374,704.40 | 0.23 |
| 187 | 603290 | 斯达半导 | 4,600 | 373,842.00 | 0.23 |
| 188 | 601231 | 环旭电子 | 25,426 | 371,982.38 | 0.23 |
| 189 | 603699 | 纽威股份 | 11,900 | 370,923.00 | 0.23 |
| 190 | 603688 | 石英股份 | 10,500 | 369,810.00 | 0.22 |
| 191 | 600329 | 达仁堂 | 10,995 | 366,793.20 | 0.22 |
| 192 | 603198 | 迎驾贡酒 | 9,300 | 366,699.00 | 0.22 |
| 193 | 603341 | 龙旗科技 | 9,000 | 365,670.00 | 0.22 |
| 194 | 600258 | 首旅酒店 | 25,868 | 365,514.84 | 0.22 |
| 195 | 601098 | 中南传媒 | 27,800 | 364,736.00 | 0.22 |
| 196 | 688778 | 厦钨新能 | 6,491 | 362,976.72 | 0.22 |
| 197 | 600995 | 南网储能 | 37,100 | 362,838.00 | 0.22 |
| 198 | 600064 | 南京高科 | 46,800 | 360,828.00 | 0.22 |
| 199 | 603127 | 昭衍新药 | 17,026 | 358,056.78 | 0.22 |
| 200 | 688676 | 金盘科技 | 10,653 | 356,342.85 | 0.22 |
| 201 | 600755 | 厦门国贸 | 58,688 | 355,062.40 | 0.22 |
| 202 | 688050 | 爱博医疗 | 5,155 | 354,921.75 | 0.22 |
| 203 | 600641 | 万业企业 | 25,140 | 348,943.20 | 0.21 |
| 204 | 601187 | 厦门银行 | 51,000 | 346,290.00 | 0.21 |
| 205 | 603529 | 爱玛科技 | 9,970 | 342,968.00 | 0.21 |
| 206 | 688123 | 聚辰股份 | 4,180 | 338,538.20 | 0.21 |
| 207 | 688318 | 财富趋势 | 2,923 | 335,911.16 | 0.20 |
| 208 | 600848 | 上海临港 | 37,000 | 335,590.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 209 | 601137 | 博威合金 | 18,800 | 334,452.00 | 0.20 |
| 210 | 600546 | 山煤国际 | 38,300 | 334,359.00 | 0.20 |
| 211 | 600993 | 马应龙 | 11,708 | 331,102.24 | 0.20 |
| 212 | 603108 | 润达医疗 | 18,660 | 329,535.60 | 0.20 |
| 213 | 601928 | 凤凰传媒 | 29,500 | 329,515.00 | 0.20 |
| 214 | 600452 | 涪陵电力 | 35,627 | 327,768.40 | 0.20 |
| 215 | 605090 | 九丰能源 | 12,600 | 325,206.00 | 0.20 |
| 216 | 600750 | 江中药业 | 14,746 | 321,905.18 | 0.20 |
| 217 | 600129 | 太极集团 | 15,100 | 321,781.00 | 0.20 |
| 218 | 601156 | 东航物流 | 24,500 | 320,705.00 | 0.19 |
| 219 | 600968 | 海油发展 | 78,600 | 320,688.00 | 0.19 |
| 220 | 600210 | 紫江企业 | 46,900 | 320,327.00 | 0.19 |
| 221 | 600399 | 抚顺特钢 | 61,000 | 318,420.00 | 0.19 |
| 222 | 600459 | 贵研铂业 | 20,529 | 318,404.79 | 0.19 |
| 223 | 600273 | 嘉化能源 | 37,600 | 318,096.00 | 0.19 |
| 224 | 601222 | 林洋能源 | 55,700 | 317,490.00 | 0.19 |
| 225 | 603456 | 九洲药业 | 20,800 | 316,368.00 | 0.19 |
| 226 | 601126 | 四方股份 | 19,300 | 314,011.00 | 0.19 |
| 227 | 603225 | 新凤鸣 | 29,472 | 313,876.80 | 0.19 |
| 228 | 603267 | 鸿远电子 | 6,240 | 313,684.80 | 0.19 |
| 229 | 601636 | 旗滨集团 | 62,200 | 311,622.00 | 0.19 |
| 230 | 603565 | 中谷物流 | 32,523 | 310,594.65 | 0.19 |
| 231 | 600801 | 华新水泥 | 26,000 | 307,840.00 | 0.19 |
| 232 | 603883 | 老百姓 | 14,642 | 307,628.42 | 0.19 |
| 233 | 688596 | 正帆科技 | 9,012 | 305,687.04 | 0.19 |
| 234 | 600057 | 厦门象屿 | 43,400 | 305,102.00 | 0.19 |
| 235 | 600933 | 爱柯迪 | 19,000 | 304,190.00 | 0.18 |
| 236 | 601598 | 中国外运 | 61,000 | 300,730.00 | 0.18 |
| 237 | 603650 | 彤程新材 | 9,300 | 298,995.00 | 0.18 |
| 238 | 600422 | 昆药集团 | 20,452 | 292,668.12 | 0.18 |
| 239 | 688029 | 南微医学 | 4,289 | 289,721.95 | 0.18 |
| 240 | 603619 | 中曼石油 | 14,300 | 287,001.00 | 0.17 |
| 241 | 603233 | 大参林 | 17,603 | 286,928.90 | 0.17 |
| 242 | 688390 | 固德威 | 6,549 | 284,554.05 | 0.17 |
| 243 | 603871 | 嘉友国际 | 26,404 | 283,843.00 | 0.17 |
| 244 | 603393 | 新天然气 | 9,784 | 283,246.80 | 0.17 |
| 245 | 600925 | 苏能股份 | 53,300 | 278,759.00 | 0.17 |
| 246 | 600373 | 中文传媒 | 27,000 | 277,290.00 | 0.17 |
| 247 | 601965 | 中国汽研 | 15,500 | 275,125.00 | 0.17 |
| 248 | 688289 | 圣湘生物 | 13,408 | 274,595.84 | 0.17 |
| 249 | 688700 | 东威科技 | 6,921 | 273,033.45 | 0.17 |
| 250 | 603583 | 捷昌驱动 | 7,372 | 269,225.44 | 0.16 |
| 251 | 603588 | 高能环境 | 47,128 | 265,801.92 | 0.16 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 252 | 600916 | 中国黄金 | 32,500 | 265,525.00 | 0.16 |
| 253 | 600428 | 中远海特 | 42,400 | 265,000.00 | 0.16 |
| 254 | 688388 | 嘉元科技 | 13,152 | 264,092.16 | 0.16 |
| 255 | 600328 | 中盐化工 | 34,030 | 260,329.50 | 0.16 |
| 256 | 603690 | 至纯科技 | 10,380 | 259,396.20 | 0.16 |
| 257 | 600782 | 新钢股份 | 73,000 | 258,420.00 | 0.16 |
| 258 | 688281 | 华秦科技 | 4,215 | 255,049.65 | 0.15 |
| 259 | 603505 | 金石资源 | 11,725 | 254,667.00 | 0.15 |
| 260 | 600116 | 三峡水利 | 37,000 | 253,450.00 | 0.15 |
| 261 | 688083 | 中望软件 | 3,924 | 252,744.84 | 0.15 |
| 262 | 600729 | 重庆百货 | 8,470 | 252,660.10 | 0.15 |
| 263 | 603218 | 日月股份 | 19,900 | 252,531.00 | 0.15 |
| 264 | 688016 | 心脉医疗 | 2,852 | 252,173.84 | 0.15 |
| 265 | 688559 | 海目星 | 7,626 | 250,895.40 | 0.15 |
| 266 | 603612 | 索通发展 | 13,500 | 248,130.00 | 0.15 |
| 267 | 603658 | 安图生物 | 6,600 | 247,500.00 | 0.15 |
| 268 | 601311 | 骆驼股份 | 27,230 | 245,886.90 | 0.15 |
| 269 | 600612 | 老凤祥 | 4,933 | 245,416.75 | 0.15 |
| 270 | 688779 | 五矿新能 | 44,747 | 243,423.68 | 0.15 |
| 271 | 688630 | 芯碁微装 | 3,049 | 241,999.13 | 0.15 |
| 272 | 603305 | 旭升集团 | 18,428 | 240,485.40 | 0.15 |
| 273 | 688408 | 中信博 | 5,069 | 236,620.92 | 0.14 |
| 274 | 688131 | 皓元医药 | 4,882 | 236,044.70 | 0.14 |
| 275 | 688349 | 三一重能 | 9,460 | 235,932.40 | 0.14 |
| 276 | 688800 | 瑞可达 | 4,760 | 234,192.00 | 0.14 |
| 277 | 600507 | 方大特钢 | 53,603 | 232,637.02 | 0.14 |
| 278 | 600409 | 三友化工 | 47,861 | 232,604.46 | 0.14 |
| 279 | 603027 | 千禾味业 | 19,895 | 230,980.95 | 0.14 |
| 280 | 600211 | 西藏药业 | 6,240 | 229,756.80 | 0.14 |
| 281 | 600012 | 皖通高速 | 13,500 | 229,230.00 | 0.14 |
| 282 | 601019 | 山东出版 | 24,200 | 229,174.00 | 0.14 |
| 283 | 600531 | 豫光金铅 | 29,500 | 228,330.00 | 0.14 |
| 284 | 688139 | 海尔生物 | 7,358 | 227,288.62 | 0.14 |
| 285 | 688696 | 极米科技 | 1,983 | 226,775.88 | 0.14 |
| 286 | 603197 | 保隆科技 | 5,800 | 226,606.00 | 0.14 |
| 287 | 688439 | 振华风光 | 3,866 | 225,194.50 | 0.14 |
| 288 | 603599 | 广信股份 | 21,076 | 224,880.92 | 0.14 |
| 289 | 603496 | 恒为科技 | 8,700 | 223,938.00 | 0.14 |
| 290 | 600123 | 兰花科创 | 34,180 | 222,853.60 | 0.14 |
| 291 | 600888 | 新疆众和 | 32,600 | 222,332.00 | 0.14 |
| 292 | 600773 | 西藏城投 | 22,100 | 222,326.00 | 0.14 |
| 293 | 600248 | 陕建股份 | 58,300 | 222,123.00 | 0.13 |
| 294 | 600866 | 星湖科技 | 32,100 | 221,811.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 295 | 603283 | 赛腾股份 | 6,500 | 220,610.00 | 0.13 |
| 296 | 600502 | 安徽建工 | 46,468 | 218,399.60 | 0.13 |
| 297 | 600389 | 江山股份 | 11,665 | 216,969.00 | 0.13 |
| 298 | 688690 | 纳微科技 | 9,366 | 213,825.78 | 0.13 |
| 299 | 601139 | 深圳燃气 | 33,400 | 212,424.00 | 0.13 |
| 300 | 600032 | 浙江新能 | 27,900 | 210,924.00 | 0.13 |
| 301 | 688100 | 威胜信息 | 5,689 | 210,777.45 | 0.13 |
| 302 | 601952 | 苏垦农发 | 21,300 | 210,231.00 | 0.13 |
| 303 | 603707 | 健友股份 | 18,715 | 208,672.25 | 0.13 |
| 304 | 600776 | 东方通信 | 18,500 | 206,090.00 | 0.13 |
| 305 | 600720 | 中交设计 | 26,600 | 205,618.00 | 0.12 |
| 306 | 688248 | 南网科技 | 6,534 | 205,559.64 | 0.12 |
| 307 | 601595 | 上海电影 | 6,900 | 204,516.00 | 0.12 |
| 308 | 688516 | 奥特维 | 6,087 | 202,331.88 | 0.12 |
| 309 | 600675 | 中华企业 | 70,100 | 201,888.00 | 0.12 |
| 310 | 603383 | 顶点软件 | 4,740 | 200,976.00 | 0.12 |
| 311 | 603279 | 景津装备 | 13,420 | 200,360.60 | 0.12 |
| 312 | 688127 | 蓝特光学 | 7,775 | 199,895.25 | 0.12 |
| 313 | 688106 | 金宏气体 | 11,154 | 199,545.06 | 0.12 |
| 314 | 600295 | 鄂尔多斯 | 22,879 | 199,276.09 | 0.12 |
| 315 | 603713 | 密尔克卫 | 3,700 | 197,284.00 | 0.12 |
| 316 | 603876 | 鼎胜新材 | 21,600 | 196,344.00 | 0.12 |
| 317 | 600395 | 盘江股份 | 41,500 | 196,295.00 | 0.12 |
| 318 | 688575 | 亚辉龙 | 13,200 | 192,588.00 | 0.12 |
| 319 | 603888 | 新华网 | 8,000 | 191,520.00 | 0.12 |
| 320 | 601869 | 长飞光纤 | 4,700 | 191,384.00 | 0.12 |
| 321 | 603556 | 海兴电力 | 7,510 | 191,279.70 | 0.12 |
| 322 | 688032 | 禾迈股份 | 1,914 | 191,132.04 | 0.12 |
| 323 | 603128 | 华贸物流 | 30,370 | 188,294.00 | 0.11 |
| 324 | 603056 | 德邦股份 | 11,800 | 187,856.00 | 0.11 |
| 325 | 601908 | 京运通 | 56,000 | 187,600.00 | 0.11 |
| 326 | 600586 | 金晶科技 | 38,700 | 186,921.00 | 0.11 |
| 327 | 601702 | 华峰铝业 | 11,600 | 184,324.00 | 0.11 |
| 328 | 600740 | 山西焦化 | 49,495 | 183,626.45 | 0.11 |
| 329 | 688639 | 华恒生物 | 5,779 | 183,194.30 | 0.11 |
| 330 | 688006 | 杭可科技 | 9,313 | 181,603.50 | 0.11 |
| 331 | 603281 | 江瀚新材 | 7,200 | 180,432.00 | 0.11 |
| 332 | 688375 | 国博电子 | 2,988 | 179,309.88 | 0.11 |
| 333 | 605123 | 派克新材 | 2,300 | 179,170.00 | 0.11 |
| 334 | 688631 | 莱斯信息 | 1,992 | 177,686.40 | 0.11 |
| 335 | 603919 | 金徽酒 | 9,800 | 177,380.00 | 0.11 |
| 336 | 603008 | 喜临门 | 10,100 | 176,548.00 | 0.11 |
| 337 | 600284 | 浦东建设 | 26,284 | 173,474.40 | 0.11 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 338 | 603786 | 科博达 | 3,100 | 171,771.00 | 0.10 |
| 339 | 603733 | 仙鹤股份 | 8,200 | 170,068.00 | 0.10 |
| 340 | 688556 | 高测股份 | 23,620 | 169,591.60 | 0.10 |
| 341 | 603866 | 桃李面包 | 30,878 | 166,741.20 | 0.10 |
| 342 | 601061 | 中信金属 | 20,800 | 164,528.00 | 0.10 |
| 343 | 601033 | 永兴股份 | 10,400 | 164,424.00 | 0.10 |
| 344 | 600223 | 福瑞达 | 19,600 | 161,112.00 | 0.10 |
| 345 | 600007 | 中国国贸 | 7,773 | 159,968.34 | 0.10 |
| 346 | 603099 | 长白山 | 4,100 | 156,046.00 | 0.09 |
| 347 | 603348 | 文灿股份 | 7,300 | 152,424.00 | 0.09 |
| 348 | 600299 | 安迪苏 | 15,600 | 150,540.00 | 0.09 |
| 349 | 603915 | 国茂股份 | 10,180 | 148,017.20 | 0.09 |
| 350 | 600648 | 外高桥 | 13,414 | 146,615.02 | 0.09 |
| 351 | 603229 | 奥翔药业 | 16,056 | 140,008.32 | 0.09 |
| 352 | 605333 | 沪光股份 | 5,100 | 139,995.00 | 0.09 |
| 353 | 600639 | 浦东金桥 | 13,182 | 139,597.38 | 0.08 |
| 354 | 600987 | 航民股份 | 19,700 | 139,279.00 | 0.08 |
| 355 | 603317 | 天味食品 | 12,376 | 137,621.12 | 0.08 |
| 356 | 603043 | 广州酒家 | 8,800 | 137,104.00 | 0.08 |
| 357 | 600662 | 外服控股 | 26,500 | 135,415.00 | 0.08 |
| 358 | 688276 | 百克生物 | 6,396 | 134,316.00 | 0.08 |
| 359 | 605009 | 豪悦护理 | 3,300 | 131,274.00 | 0.08 |
| 360 | 605168 | 三人行 | 4,094 | 120,486.42 | 0.07 |
| 361 | 603025 | 大豪科技 | 8,540 | 119,730.80 | 0.07 |
| 362 | 601858 | 中国科传 | 6,100 | 118,645.00 | 0.07 |
| 363 | 601330 | 绿色动力 | 15,300 | 116,892.00 | 0.07 |
| 364 | 601882 | 海天精工 | 6,100 | 116,510.00 | 0.07 |
| 365 | 603327 | 福蓉科技 | 11,586 | 107,170.50 | 0.07 |
| 366 | 688348 | 昱能科技 | 2,411 | 103,600.67 | 0.06 |
| 367 | 601158 | 重庆水务 | 22,300 | 103,472.00 | 0.06 |
| 368 | 601022 | 宁波远洋 | 10,100 | 99,687.00 | 0.06 |
| 369 | 603355 | 莱克电气 | 4,420 | 99,096.40 | 0.06 |
| 370 | 603989 | 艾华集团 | 6,200 | 95,480.00 | 0.06 |
| 371 | 603730 | 岱美股份 | 16,610 | 94,510.90 | 0.06 |
| 372 | 688268 | 华特气体 | 1,856 | 93,486.72 | 0.06 |
| 373 | 600956 | 新天绿能 | 11,900 | 91,868.00 | 0.06 |
| 374 | 688526 | 科前生物 | 5,454 | 84,973.32 | 0.05 |
| 375 | 601512 | 中新集团 | 11,600 | 84,912.00 | 0.05 |
| 376 | 688295 | 中复神鹰 | 3,894 | 80,995.20 | 0.05 |
| 377 | 603708 | 家家悦 | 7,360 | 75,072.00 | 0.05 |
| 378 | 605222 | 起帆电缆 | 4,800 | 72,672.00 | 0.04 |
| 379 | 603868 | 飞科电器 | 1,900 | 68,153.00 | 0.04 |
| 380 | 601811 | 新华文轩 | 4,600 | 67,022.00 | 0.04 |

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688775 | 影石创新 | 128 | 15,892.48 | 0.01 |
| 2 | 688757 | 胜科纳米 | 536 | 13,903.84 | 0.01 |

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600839 | 四川长虹 | 1,378,274.00 | 0.74 |
| 2 | 689009 | 九号公司 | 1,310,437.88 | 0.71 |
| 3 | 601555 | 东吴证券 | 1,286,140.00 | 0.69 |
| 4 | 688608 | 恒玄科技 | 1,228,418.83 | 0.66 |
| 5 | 600157 | 永泰能源 | 1,159,495.00 | 0.62 |
| 6 | 600096 | 云天化 | 1,124,845.00 | 0.61 |
| 7 | 688777 | 中控技术 | 1,074,578.96 | 0.58 |
| 8 | 601168 | 西部矿业 | 1,065,365.00 | 0.57 |
| 9 | 600460 | 士兰微 | 1,062,190.00 | 0.57 |
| 10 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,050,836.00 | 0.57 |
| 11 | 600219 | 南山铝业 | 1,024,547.00 | 0.55 |
| 12 | 688469 | 芯联集成 | 879,730.66 | 0.47 |
| 13 | 600298 | 安琪酵母 | 836,110.00 | 0.45 |
| 14 | 603606 | 东方电缆 | 791,240.84 | 0.43 |
| 15 | 603605 | 珀莱雅 | 763,486.00 | 0.41 |
| 16 | 600332 | 白云山 | 726,562.00 | 0.39 |
| 17 | 600895 | 张江高科 | 725,157.00 | 0.39 |
| 18 | 603160 | 汇顶科技 | 718,530.00 | 0.39 |
| 19 | 603659 | 璞泰来 | 685,980.00 | 0.37 |
| 20 | 600918 | 中泰证券 | 668,043.00 | 0.36 |

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601825 | 沪农商行 | 2,370,266.00 | 1.28 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2 | 601838 | 成都银行 | 2,062,959.00 | 1.11 |
| 3 | 601077 | 渝农商行 | 1,871,046.00 | 1.01 |
| 4 | 600183 | 生益科技 | 1,420,592.00 | 0.76 |
| 5 | 600066 | 宇通客车 | 1,370,959.00 | 0.74 |
| 6 | 600741 | 华域汽车 | 1,187,911.00 | 0.64 |
| 7 | 601021 | 春秋航空 | 1,161,433.36 | 0.62 |
| 8 | 601877 | 正泰电器 | 999,700.00 | 0.54 |
| 9 | 600233 | 圆通速递 | 931,625.00 | 0.50 |
| 10 | 603296 | 华勤技术 | 878,873.00 | 0.47 |
| 11 | 601808 | 中海油服 | 351,274.00 | 0.19 |
| 12 | 600377 | 宁沪高速 | 330,510.50 | 0.18 |
| 13 | 600350 | 山东高速 | 317,716.00 | 0.17 |
| 14 | 603067 | 振华股份 | 311,441.00 | 0.17 |
| 15 | 601298 | 青岛港 | 264,266.00 | 0.14 |
| 16 | 600571 | 信雅达 | 246,650.00 | 0.13 |
| 17 | 688518 | 联赢激光 | 245,006.17 | 0.13 |
| 18 | 688617 | 惠泰医疗 | 243,324.66 | 0.13 |
| 19 | 601577 | 长沙银行 | 240,682.00 | 0.13 |
| 20 | 601456 | 国联民生 | 221,027.00 | 0.12 |

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 31,358,246.87 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 30,183,163.27 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票（如有）没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 315.32 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 315.32 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 688775 | 影石创新 | 15,892.48 | 0.01 | 新股锁定期 |
| 2 | 688757 | 胜科纳米 | 13,903.84 | 0.01 | 新股锁定期 |

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | | 南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 985 | 81,674.03 | 3,922,799.00 | 4.88% | 8,534,575.00 | 10.61% | 67,991,541.00 | 84.52% |

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 广发证券股份有限公司 | 2,095,700.00 | 2.61% |
| 2 | 中信证券股份有限公司 | 782,836.00 | 0.97% |
| 3 | 北京无限立通通讯技术有限责任公司 | 609,600.00 | 0.76% |
| 4 | 李月环 | 433,100.00 | 0.54% |
| 5 | 华泰证券股份有限公司 | 431,400.00 | 0.54% |
| 6 | 黄静 | 308,700.00 | 0.38% |
| 7 | 戴万青 | 300,000.00 | 0.37% |
| 8 | 王钧璧 | 165,300.00 | 0.21% |
| 9 | 陈致运 | 154,400.00 | 0.19% |
| 10 | 纪双荣 | 150,000.00 | 0.19% |
| 11 | 中国建设银行股份有限公司－南方上证 380 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 67,991,541.00 | 84.52% |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2011 年 9 月 16 日)基金份额总额 | 330,448,915.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 94,448,915.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 16,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 80,448,915.00 |

# §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内无涉及基金财产的诉讼事项。

本报告期无涉及基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 华泰证券 | 3 | 60,312,510.47 | 98.18% | 6,037.06 | 98.18% | - |
| 国盛证券 | 1 | 1,119,894.32 | 1.82% | 111.80 | 1.82% | - |
| 申万宏源 | 3 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰海通 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：根据 2024 年 7 月 1 日起施行的《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3 号），基金管理人制定了证券公司交易单元的选择标准和程序：

1、选择标准

基金管理人建立了选择机制，选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司参与证券交易，并制定了定性与定量相结合的具体标准。

2、选择程序

（1）基金管理人根据上述标准对证券公司进行评估，与符合标准的证券公司签订交易单元租用协议后将其入库，并对入库的证券公司开展动态管理，定期检视其是否持续符合选择标准；

（2）基金管理人根据其建立的服务评价及交易量分配机制，定期对证券公司开展评价后，根据评价结果进行交易量的分配。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：新增交易单元：国盛证券；减少交易单元：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 华泰证券 | 103,791.61 | 87.65% | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 13,478.02 | 11.38% | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰海通 | 1,141.19 | 0.96% | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 南方基金关于直销平台相关业务费率优惠的公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025-01-01 |
| 2 | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加华金证券为一级交易商的公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025-01-08 |
| 3 | 南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加瑞银证券为一级交易商的公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025-02-20 |
| 4 | 关于南方基金管理股份有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025-03-19 |
| 5 | 南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告 | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025-03-20 |
| 6 | 南方基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度） | 证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025-03-31 |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 超过 20%的时间区间 | | | | | |
| 联接基金 | 1 | 20250101-20250630 | 76,513,441.00 | 12,000,000.00 | 20,521,900.00 | 67,991,541.00 | 84.52% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在特定赎回比例及市场条件下，若基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产，将会导致流动性风险和基金净值波动风险。 | | | | | | | |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立上证 380 交易型开放式指数证券投资基金的文件；

2、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

3、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；

6、《上证 380 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年中期报告》原文。

### 12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 12.3 查阅方式

网站：http://www.nffund.com